



TITLE:

D-安定性 (位相幾何学と経済学)

AUTHOR(S):

戸川, 美郎

CITATION:

戸川, 美郎. D-安定性 (位相幾何学と経済学). 数理解析研究所講究録
1980, 407: 10-18

ISSUE DATE:

1980-12

URL:

<http://hdl.handle.net/2433/102365>

RIGHT:

D-安定性

東理大 理工 戸川美郎

今、 n 種の商品があるとして、 $P = (P_1, \dots, P_n)$ をそれらの価格とする。価格 P に対して、超過需要 $E(P) = (E_1(P), \dots, E_n(P))$ が定まり、これは転じて価格 P に影響を与える。そこで、最も単純なモデルを考えようならば、それは

$$\frac{dP}{dt} = E(P) \quad \dots (i)$$

である。そして $E(P_0) = 0$ となる価格 P_0 が重要である。このような価格 P_0 は、時間がたっても変化しない。さて、 $E(P_0) = 0$ であるだけでは、まだたいした意味を持たない。安定な均衡点 P_0 、すなわち、 P_0 の付近の点はすべて時間がたつと P_0 へと漸近的に近づいて行くような均衡点 P_0 が重要である。ここでは、記述を簡単にすむために、(適当に原点を移動して) $E(0) = 0$ としておこう。原点で E を展開すると、 A は E の原

点でのヤコブ行列 $(\partial E_j / \partial p_k)_{p=0}$ として,

$$\frac{dP}{dt} = AP + 2\text{次以上の項}$$

となる。原点は安定均衡点であるということは、 A が安定行列であること、すなわち A の固有値の実部はすべて負であるということである。厳密に言えば、 A の固有値の実部がすべて負でなくとも、すべて非正であり2次以上の項が適切であれば、安定均衡点でありうる。しかし、このような場合には A に極くわずかの擾動を加えて安定均衡点でなくすることができ、安定均衡であっても構造不安定であり、重要さを欠く。このように、モデル(i)に関しては、均衡点か安定であるかどうかの判定は容易である。ここで、もう少し複雑なモデルを考えよう。商品 j の価格 p_j の変化 $\frac{dp_j}{dt}$ は、(i) で仮定したように単に超過需要 E_j に等しいというのではなく、 E_j のある関数であるとする。すなわち、

$$\frac{dp_j}{dt} = f_j(E_j(p)) \quad \dots (ii)$$

とする。ただし、関数 f_j は、 $f_j(0) = 0$ であり $f'_j(0) > 0$ であるという以外には具体的に特定できないとする。 $E(0) = 0$

であれば, $f_j(E_j(0))=0$, $j=1, \dots, n$ であり原点は均衡点である。ここでは、そのように仮定する。さて、この均衡点の安定性が問題になる。(ii)を展開すると,

$$\frac{dP}{dt} = BP + 2\text{次以上の項}$$

となる。ただし、 $B = (\partial(f_j \circ E_j) / \partial P_k)_{P=0}$ である。そこで、 B が安定行列であればよい。 B の成分をもう少し計算すると、 $\partial(f_j \circ E_j) / \partial P_k = J'_j(0) \cdot \partial E_j / \partial P_k (P=0)$ であり、 $D = \text{diag}(J'_1(0), \dots, J'_n(0))$ とすると

$$B = DA$$

であることがわかる。行列 D に関しては、対角行列であり対角成分はすべて正、という以外は何もわからない。そこで D -安定の概念が必要になる。

定義 $n \times n$ 行列が D -安定であるとは、対角成分がすべて正であるような任意の対角行列 D に対して DA が安定であること

行列 A が与えられたとき、それが安定かどうかを判定するこ

とは, Routh-Hurwitz の判定条件により可能である。しかし, A が D -安定であるかを (有限回の操作で) 判定する条件は, 今の所 4 次以上の場合には知られていない。従来, この問題に対して, 行列論的手法による多くのアプローチが試みられてきたが [], ここでは, D -安定な行列全体の集合を幾何学的に調べることによるアプローチを述べる。以下では, 行列 A が安定であるとは, A のすべての固有値の実部が正であること (負ではなく!) とし, D -安定性もこの意味で定義する。こうすることにより, $(-1)^k$ が煩雑にかかってくるのを除くことができる。 A がこの意味で安定 (もしくは D -安定) なら, $-A$ は普通の意味で安定 (D -安定) である。

$n \times n$ 実行列全体の空間 M_n の中で, D -安定なものの集合 DS_n を考える。 D_n を対角成分がすべて正な $n \times n$ 対角行列の全体, \widetilde{D}_n を $n \times n$ 対角行列の全体とする。 D_n は積に関して群であり, M_n に $(D, A) \longrightarrow DA$ と作用する。 $A \in M_n$ に対し, この群 D の作用による軌道 $\{DA \mid D \in D_n\}$ を $D_n A$ で表わす。これは $\det A \neq 0$ であれば n 次元であり, 線形部分空間 $\widetilde{D}_n A = \{DA \mid D \in \widetilde{D}_n\}$ の [第 1 象限] である。 V_n と, $V_n = \{A \in M_n \mid \det A \neq 0 \text{ であり, } A \text{ は実部 } 0 \text{ の固有値を持たない}\}$ と定義する。 V_n は 大部分のところでは滑らかな $n^2 - 1$ 次元

超曲面であるが、特異点を持つ。

固有値の連続性から、 A が D -安定である必要充分条件は A が安定であり $D_n A$ は V_n と交わらないこと、であることがわかる。

さて、 D -安定性の問題での最終目標は、集合 DS_n を適当な不等式系で特徴づけることである。そのために、 DS_4 の境界 $B(DS_4)$ に注目して、そこで起っている現象を調べよう。すると $B(DS_4)$ はいくつかの部分に分けられ、第1の部分では現象 P_1 が起き、第2の部分では現象 P_2 が起き……というふうになるだろう。次に、各 P_i に対し、 $A = (a_{jk}) \in M_n$ で現象 P_i が起きているならば $f_i(a_{jk}) = 0$ となるような関数 f_i を見つける。すると第 i 番目の部分は f_i の零点（超曲面になる、特異点があるかもしれない）に含まれ、 $B(DS_4)$ は各 i についての f_i の零点（超曲面）の合併に含まれることになり、 DS_4 は、これらの超曲面により切り取られる部分のいくつか（もしくは、いくつか）である。結局、 DS_4 は、これらの f_i を適切に組み合わせて超曲面不等式系を作ることにより特徴づけられることになる。（こういった議論が可能なのは、実は、 DS_4 , $B(DS_4)$ といった集合は semi-algebraic set であり、これらの関数としては、原理的には多項式を選ぶことができるからである）

まず $B(DS_4)$ を次の2つの部分に分ける。

$$B_a(DS_4) = B(DS_4) \setminus DS_4$$

$$B_b(DS_4) = B(DS_4) \cap DS_4$$

最初に $B_a(DS_4)$ を調べよう。 $A \in B_a(DS_4)$ ならば、 $D_n A$ は V_n と交わるが、この交わりは、ごくわずかの擾動によりはずすことができる。従って、この交わりは非横断的である。
 $\widehat{A} \in D_n A \cap V_n$ として、 $D_n A$ と V_n との交わりが \widehat{A} で横断的でないという条件を求めると、次のようになる。

$$\det(\widehat{A} - i\lambda I) = 0 \quad \text{であり、}$$

複素数 $(\widehat{A} - i\lambda I)_1, (\widehat{A} - i\lambda I)_2, \dots, (\widehat{A} - i\lambda I)_n$ は、2次元実ベクトル空間の元として線型従属となるような $\lambda \in \mathbb{R}$ が存在する。ただし $(\widehat{A} - i\lambda I)_j$ は、行列 $\widehat{A} - i\lambda I$ の j 行 j 列を除いた小行列の行列式とする。

証明は []。そこで、 $A \in B_a(DS_n)$ ならば、 $D = (d_{ij})$ を適当に選んで、 $\widehat{A} = DA$ が上の条件を満たすようにできなければ、逆に言うならば、上の条件から未知数 $\lambda, d_{11}, \dots, d_{nn}$ を消去すれば、 $B_a(DS_n)$ を零点に含むような関数が得られる筈である。しかし、この消去は、 $n \geq 4$ の場合には今のところできない ($n \leq 3$ なら、すぐ消去でき、 DS_4 の特徴づけを得ることができ)。しかし、この特徴づけは、すでに別の方

法で得られている []。上の条件では、実は、 \hat{A} は V_4 の特異点ではないとしている。 $n \leq 4$ の場合には、こう仮定しても本質的差は生じない [] のだが、 $n \geq 5$ なら、この場合は別に考慮しなければならない。しかし、まず上の条件での消去が出来てからでない限り、このような場合 (stratification の概念が必要になる) の研究に着手してもあまり意味はないであろう。

次に $B(DS_n)$ を調べる。 $A \in B(DS_n)$ とすると、 $D_n A$ と V_n は交わらないのだが、 A をわずかに擾動することにより交わりを作ることができ。このことは、 $D_n A$ の境界と V_n が交わっているか、もしくは $D_n A$ と V_n が、“無限遠で” 交わっていることを意味する。しかし、後者のケースは、 D_n と V_n はスカラー倍により不変なのであり得ない。そこで、 $D_n A$ の境界と V_n が交わる条件を調べると、次の定理が得られる []

$A \in B(DS_n)$ ならば、 A の主小行列のひとつか、もしくは A^T の主小行列のひとつかが $B(DS_{n-1})$ に含まれる。

この定理は、 $n-1$ 次の D-安定性問題が解決されていればそれらの零点の合併が $B_b(DS_n)$ を含むような関数を書き下すことができることを示している。 $B_b(DS_n)$ は $B_a(DS_n)$ のよう

に新しい困難を付け加えることはしない。結局、本質的なのは、先の条件での消去である。ところで、上の定理で、「 A の主小行列……」だけでなく「 A^{-1} の主小行列……」が表われるのは、多少意外であるが、これは本質的であり落とすことができない。実際、これがあつたために、複産物として、次の

Johnson problem

A がD-安定なら $A+I$ もD-安定か？

の反例を作ることができる。

$$\begin{bmatrix} 100 & 70 & 70 & 280 \\ -400 & 100 & 70 & 280 \\ -400 & -400 & 100 & 280 \\ 1 & 1 & 1 & 4 \end{bmatrix}$$

は、この反例となっている []。

REFERENCES

1. C.A. Bahl and B.E. Chain, The inertia of Diagonal Multiples of 3×3 Real Matrices, Lin. Alg. and Appl. 18, 267-280 (1977)

2. C.R. Johnson, Sufficient conditions for D-stability, J. Econ. Theory 9 (1974), 53~62
3. Y. Togawa, A geometric study of D-stability problem, preprint